

Tabela punktów swapowych

Obowiązuje w dniach 2019.01.21 - 2019.01.27 Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-11.5175	6.6196
CADCHF.pro	3.3341	-6.8262
CADJPY.pro	2.4051	-5.9331
CHFJPY.pro	-4.5339	-0.7634
EURCAD.pro	-11.9896	5.5648
EURCHF.pro	-1.6227	-3.8128
EURGBP.pro	-4.8176	0.9350
EURJPY.pro	-3.6885	-1.8184
GBPCAD.pro	-7.9919	0.7389
GBPCHF.pro	2.3320	-8.4692
GBPJPY.pro	0.4116	-6.6287
GBPUSD.pro	-8.8329	3.3043
USDCAD.pro	0.1108	-5.6487
USDCHF.pro	6.5645	-11.2603
USDJPY.pro	5.5411	-10.2904
AUDCHF.pro	3.5490	-7.6838
AUDCAD.pro	-1.4535	-3.5414
AUDJPY.pro	2.7024	-6.9525
AUDNZD.pro	-2.2755	-4.0788
AUDUSD.pro	-2.6643	-1.1334
CHFPLN.pro	-3.3713	1.3532
EURAUD.pro	-15.2496	6.6874

EURCZK.pro	-2.1155	0.7718
EURHUF.pro	-1.4443	-1.0383
EURNOK.pro	-5.9638	1.2038
EURNZD.pro	-14.4400	6.0356
EURPLN.pro	-3.3245	1.2065
EURSEK.pro	-3.1188	-1.9798
EURTRY.pro	-503.4078	321.5226
GBPAUD.pro	-11.3915	1.7241
GBPNZD.pro	-10.1043	0.6141
GBPLN.pro	-2.1786	-0.2127
NZDJPY.pro	2.0687	-5.7565
NZDUSD.pro	-2.9341	-0.3551
USDCZK.pro	-0.0563	-1.1068
USDHUF.pro	0.9706	-3.1305
USDNOK.pro	1.6167	-5.7310
USDPLN.pro	0.1020	-1.9331
USDSEK.pro	4.4815	-8.8896
USDTRY.pro	-399.5198	240.0744
EURZAR.pro	-54.0197	10.0194
USDZAR.pro	-36.3710	-2.1969
SILVER.pro	-1.1934	0.8724
GOLD.pro	-10.0172	7.3184
COPPER.pro	-0.4699	0.3433
EURUSD.std	-13.4134	4.7237
CADCHF.std	2.0838	-8.0767

CADJPY.std	1.0308	-7.3076
CHFJPY.std	-6.3658	-2.5954
EURCAD.std	-14.5094	3.0449
EURCHF.std	-3.5133	-5.7034
EURGBP.std	-6.2829	-0.5304
EURJPY.std	-5.7666	-3.8965
GBPCAD.std	-10.8187	-2.0881
GBPCHF.std	0.2111	-10.5902
GBPJPY.std	-1.9196	-8.9601
GBPUSD.std	-10.9598	1.1774
USDCAD.std	-2.1043	-7.8638
USDCHF.std	4.9027	-12.9222
USDJPY.std	3.7144	-12.1169
AUDCHF.std	2.3594	-8.8735
AUDCAD.std	-3.0391	-5.1271
AUDJPY.std	1.3948	-8.2601
AUDNZD.std	-4.0486	-5.8521
AUDUSD.std	-3.8572	-2.3265
CHFPLN.std	-3.9976	0.7264
EURAUD.std	-17.8980	4.0389
EURCZK.std	-2.5422	0.3450
EURHUF.std	-1.9744	-1.5685
EURNOK.std	-7.5867	-0.4193
EURNZD.std	-17.2577	3.2174
EURPLN.std	-4.0351	0.4957

EURSEK.std	-4.8277	-3.6889
EURTRY.std	-508.4757	316.4526
GBPAUD.std	-14.3626	-1.2473
GBPNZD.std	-13.2654	-2.5474
GBPLN.std	-2.9757	-1.0102
NZDJPY.std	0.8398	-6.9856
NZDUSD.std	-4.0554	-1.4765
USDCZK.std	-0.4313	-1.4820
USDHUF.std	0.5047	-3.5966
USDNOK.std	0.1902	-7.1577
USDPLN.std	-0.5227	-2.5580
USDSEK.std	2.9793	-10.3920
USDTRY.std	-403.9722	235.6211
EURZAR.std	-55.3350	8.7038
USDZAR.std	-37.5272	-3.3532
SILVER.std	-1.3204	0.7454
GOLD.std	-11.0828	6.2526
COPPER.std	-0.5199	0.2933
AUDCAD	-3.0391	-5.1271
AUDCHF	2.3594	-8.8735
AUDJPY	1.3948	-8.2601
AUDNZD	-4.0486	-5.8521
AUDUSD	-3.8572	-2.3265
CADCHF	2.0838	-8.0767
CADJPY	1.0308	-7.3076

CHFJPY	-6.3658	-2.5954
CHFPLN	-39.9758	7.2636
EURAUD	-17.8980	4.0389
EURCAD	-14.5094	3.0449
EURCHF	-3.5133	-5.7034
EURCZK	-25.4220	3.4498
EURGBP	-6.2829	-0.5304
EURHUF	-19.7437	-15.6855
EURJPY	-5.7666	-3.8965
EURNOK	-75.8667	-4.1930
EURNZD	-17.2577	3.2174
EURPLN	-40.3511	4.9566
EURSEK	-48.2770	-36.8892
EURTRY	-508.4757	316.4526
EURUSD	-13.4134	4.7237
EURZAR	-553.3500	87.0383
GBPAUD	-14.3626	-1.2473
GBPCAD	-10.8187	-2.0881
GBPCHF	0.2111	-10.5902
GBPJPY	-1.9196	-8.9601
GBPPLN	-29.7570	-10.1024
GBPUSD	-10.9598	1.1774
NZDJPY	0.8398	-6.9856
NZDUSD	-4.0554	-1.4765
USDCAD	-2.1043	-7.8638

USDCHF	4.9027	-12.9222
USDCZK	-4.3129	-14.8202
USDHUF	5.0474	-35.9656
USDJPY	3.7144	-12.1169
USDNOK	1.9020	-71.5774
USDPLN	-5.2269	-25.5795
USDSEK	29.7935	-103.9197
USDTRY	-403.9722	235.6211
USDZAR	-375.2720	-33.5320
USDMXN	-55.7909	5.1812
XAGUSD	-1.3204	0.7454
XAUUSD	-11.0828	6.2526
COPPER	-0.5199	0.2933
AUDCAD.stp	-1.4535	-3.5414
AUDCHF.stp	3.5490	-7.6838
AUDJPY.stp	2.7024	-6.9525
AUDNZD.stp	-2.2755	-4.0788
AUDUSD.stp	-2.6643	-1.1334
CADCHF.stp	3.3341	-6.8262
CADJPY.stp	2.4051	-5.9331
CHFJPY.stp	-4.5339	-0.7634
CHFPLN.stp	-3.3713	1.3532
EURAUD.stp	-15.2496	6.6874
EURCAD.stp	-11.9896	5.5648
EURCHF.stp	-1.6227	-3.8128

EURGBP.stp	-4.8176	0.9350
EURJPY.stp	-3.6885	-1.8184
EURNOK.stp	-59.6380	12.0381
EURNZD.stp	-14.4400	6.0356
EURPLN.stp	-3.3245	1.2065
EURSEK.stp	-31.1875	-19.7979
EURTRY.stp	-503.4078	321.5226
EURUSD.stp	-11.5175	6.6196
GBPAUD.stp	-11.3915	1.7241
GBPCAD.stp	-7.9919	0.7389
GBPCHF.stp	2.3320	-8.4692
GBPJPY.stp	0.4116	-6.6287
GBPNZD.stp	-10.1043	0.6141
GBPPLN.stp	-2.1786	-0.2127
GBPUSD.stp	-8.8329	3.3043
NZDUSD.stp	-2.9341	-0.3551
USDCAD.stp	0.1108	-5.6487
USDCHF.stp	6.5645	-11.2603
USDHKD.stp	24.1877	-56.0023
USDJPY.stp	5.5411	-10.2904
USDNOK.stp	16.1672	-57.3100
USDPLN.stp	0.1020	-1.9331
USDSEK.stp	44.8151	-88.8959
USDTRY.stp	-399.5198	240.0744
XAGUSD.stp	-11.9342	8.7244

XAUUSD.stp	-100.1719	73.1844
3M	-2.7235	0.0000
AMAZON	-23.5865	0.0000
AIG	-0.6139	0.0000
APPLE	-2.1805	0.0000
AT&T	-0.4302	0.0000
BABA	-2.1833	0.0000
BOEING	-5.0722	0.0000
CHEVRON	-1.5904	0.0000
CISCO	-0.6262	0.0000
CITI	-0.8777	0.0000
COCACOLA	-0.6620	0.0000
EBAY	-0.4311	0.0000
EXXONM	-1.0145	0.0000
FACEBOOK	-2.0860	0.0000
GE	-0.1258	0.0000
GMOTORS	-0.5369	0.0000
GOOGLE	-15.3900	0.0000
IBM	-1.7219	0.0000
INTEL	-0.6843	0.0000
J&J	-1.8166	0.0000
JPMORGAN	-1.4541	0.0000
MCDONALD	-2.5376	0.0000
MICROSFT	-1.4976	0.0000
PFIZER	-0.5913	0.0000

P&G	-1.2706	0.0000
STBUCKS	-0.8997	0.0000
WALMART	-1.3587	0.0000
GOLDMAN	-2.8164	0.0000
UPS	-1.4128	0.0000
ALCOA	-0.4072	0.0000
AMERICANEXP	-1.3971	0.0000
BOA	-0.4073	0.0000
CATERPILLAR	-1.8995	0.0000
SNAP	-0.0859	0.0000
DISNEY	-1.5444	0.0000
FORD	-0.1193	0.0000
FEDEX	-2.4604	0.0000
HARLEY-DAVI	-0.5203	0.0000
HP	-0.2041	0.0000
NIKE	-1.1186	0.0000
PEPSI	-1.5300	0.0000
PM	-1.0261	0.0000
TWITTER	-0.4626	0.0000
VISA	-1.9259	0.0000
PAYPAL	-1.2672	0.0000
TESLA	-4.2030	0.0000
NETFLIX	-4.7144	0.0000
BASF	-3.7566	-5.2664
DTELEKOM	-0.8394	-1.1770

ALLIANZ	-10.6603	-14.9441
BAYER	-3.8318	-5.3726
BEIERSDO	-5.0821	-7.1251
DAIMLERC	-2.9291	-4.1073
DBANK	-0.4615	-0.6471
SIEMENS	-5.8026	-8.1351
LUFTHANS	-1.2254	-1.7193
CECONOMY	-0.2051	-0.2878
ADIDAS	-11.8377	-16.6010
BMW	-4.2187	-5.9141
COMMERZBANK	-0.3861	-0.5416
CONTINENTAL	-7.7752	-10.9025
HENKEL	-5.1434	-7.2110
RWE	-1.1583	-1.6244
THYSSEN	-0.9253	-1.2974
VOLKSWAGEN	-8.4720	-11.8914
BARCLAYS	-1.4635	-0.7990
GSK	-13.2930	-7.2569
M&S	-2.5168	-1.3746
RBS	-2.1747	-1.1874
ROLLS-ROYCE	-7.9652	-4.3491
RIOTINTO	-34.7390	-18.9668
SHELL	-21.1049	-11.5233
STAN	-5.5494	-3.0297
TESCO	-1.9656	-1.0737

UNILEVER	-36.0595	-19.6875
VODAFONE	-1.3210	-0.7211
SANTANDER	-0.2506	-0.3514
TELEFONICA	-0.4439	-0.6224
BBVA	-0.2994	-0.4199
IBERDOLA	-0.4068	-0.5703
REPSOL	-0.8646	-1.2122
CAIXABANK	-0.1900	-0.2665
REDELECTRIC	-1.1343	-1.5908
GRIFOLS	-1.4220	-1.9949
BANKINTER	-0.4065	-0.5700
MAPFRE	-0.1428	-0.2004
ACS	-2.0495	-2.8744
AMADEUS	-3.7739	-5.2932
INDITEX	-1.3746	-1.9276
ACERINOX	-0.5489	-0.7706
AENA	-8.4200	-11.8104
BANKIA	-0.1480	-0.2076
IAG	-0.4104	-0.5757
SACYR	-0.1168	-0.1639
TECNICAS	-1.3075	-1.8384
BOGDANKA	-0.6080	-0.1270
BUDIMEX	-1.2930	-0.2695
CCC	-2.0950	-0.4361
MBANK	-5.0814	-1.0570

ASSECOPL	-0.5410	-0.1130
SANTANDERPL	-4.2330	-0.8821
EUROCASH	-0.2270	-0.0472
KGHM	-1.0322	-0.2145
LOTOS	-1.0875	-0.2260
MILLENNI	-0.1046	-0.0218
NETIA	-0.0593	-0.0124
ORANGEPL	-0.0614	-0.0128
PEKAO	-1.3084	-0.2719
PGE	-0.1148	-0.0239
PGNIG	-0.0830	-0.0173
PKNORLEN	-1.2562	-0.2612
PKOBP	-0.4591	-0.0954
CDPROJEKT	-1.9464	-0.4048
PZU	-0.4977	-0.1034
CYFRPLST	-0.2600	-0.0541
ALIOR	-0.6108	-0.1271
HANDLOWY	-0.7906	-0.1649
CIECH	-0.5635	-0.1175
INGBSK	-2.1778	-0.4543
JSW	-0.7520	-0.1565
PKPCARGO	-0.5087	-0.1060
TAURON	-0.0246	-0.0051
LPP	-90.5129	-18.8258
ASHR.ETF	-0.3271	0.0004

DBA.ETF	-0.2400	0.0003
DBC.ETF	-0.2161	0.0003
EEM.ETF	-0.5781	0.0007
EFA.ETF	-0.8634	0.0010
EWA.ETF	-0.2859	0.0003
EWV.ETF	-0.6266	0.0008
EWY.ETF	-0.8544	0.0010
EWZ.ETF	-0.6007	0.0007
FXI.ETF	-0.5753	0.0007
GLD.ETF	-1.6831	0.0020
HYG.ETF	-1.1749	0.0014
IVV.ETF	-3.7270	0.0045
IYR.ETF	-1.1070	0.0013
OIH.ETF	-0.2397	0.0003
SLV.ETF	-0.2000	0.0002
SPY.ETF	-3.7047	0.0044
SSO.ETF	-1.4584	0.0017
SVXY.ETF	-0.6593	0.0008
TBT.ETF	-0.5044	0.0006
VNQ.ETF	-1.1042	0.0013
VXX.ETF	-0.5152	0.0006
XHB.ETF	-0.4907	0.0006
XLB.ETF	-0.7438	0.0009
XLE.ETF	-0.8876	0.0011
XLF.ETF	-0.3614	0.0004

XLI.ETF	-0.9755	0.0012
XLP.ETF	-0.7291	0.0009
XLU.ETF	-0.7388	0.0009
XLV.ETF	-1.2525	0.0015
XLY.ETF	-1.4857	0.0018
BITCOIN	-73.3741	-25.4558
BTCUSD	-250.1791	-202.3688
ETHUSD	-82.5193	-66.7259
LTCUSD	-21.8193	-17.6845
BCHUSD	-8.5749	-6.9651
XRPUSD	-22.4278	-18.1478

Maksymalna wielkość marży na stopę procentową przy kalkulacji punktów swapowych została określona w Tabeli Opłat i Prowizji dla danej usługi. Do ustalenia w/w Punktów Swapowych TMS Brokers zastosował marżę w wysokości:

TMS	
Wysokość prowizji na stopy procentowe uwzględniana przy kalkulacji punktów swapowych	
EURTRY, USDTRY, EURZAR, USDZAR, USDMXN, EURTRY.stp, USDTRY.stp, EURTRY.pro, USDTRY.pro, EURZAR.pro, USDZAR.pro, EURTRY.std, USDTRY.std, EURZAR.std, USDZAR.std,	4,00%
Akcje i ETF'y	2,50%
Pozostałe FX + FX(.std) oraz COPPER, XAGUSD, XAUUSD, COPPER.std, GOLD.std, SILVER.std	0,65%
Pozostałe FX (.pro) + FX (.stp), XAGUSD.stp, XAUUSD.stp, COPPER.pro, GOLD.pro, SILVER.pro	0.35%
BITCOIN	5,00%
BTCUSD, ETHUSD, LTCUSD, BCHUSD, XRPUSD	23,00%

Wzory na obliczanie punktów swapowych CFD opartych o waluty, kryptowaluty, złoto, srebro oraz miedź (punkty swapowe dla CFD opartych o wartość kryptowalut, złota,

srebra oraz miedzi są wyliczane w oparciu formułę właściwą dla wyznaczania punktów swapowych dla instrumentów o charakterze walutowym, z takim jednak zastrzeżeniem, że oprocentowanie wyznaczone jest tylko dla jednej waluty, w której kwotowany jest instrument bazowy).

$$long\ swap = -(kurs\ spot_{BID} \times \frac{(1 + (stopa\ \% waluty\ kwotowanej_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% waluty\ bazowej_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})} - kurs\ spot_{BID}) \times mnożnik$$

$$short\ swap = (kurs\ spot_{ASK} \times \frac{(1 + (stopa\ \% waluty\ kwotowanej_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% waluty\ bazowej_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})} - kurs\ spot_{ASK}) \times mnożnik$$

long swap - wartość punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

kurs spot BID,ASK – kurs danej pary walutowej w momencie kalkulowania punktów swapowych BID lub ASK;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

T - oznacza ilość dni wg przyjętej dla danej waluty konwencji (np. dla USD rok ma 360 dni, podczas gdy dla PLN 365 dni);

mnożnik - współczynnik wynikający z minimalnego kroku notowań, np. dla EURUSD minimalny krok notowań to 0.00001 dlatego mnożnik w przypadku kalkulacji punktów swapowych będzie wynosił 100 000;

stopa % waluty bazowej/kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje kwotowania z rynku międzybankowego na podstawie instrumentów przedstawionych w poniższej tabeli:

Waluta	Symbol w Bloomberg	Konwencja liczenia dni (T)	Nazwa stopy Procentowej
EUR	EUDR1Z CMPN Curncy	360	Euro 1 Week Deposit
USD	USDR1Z CMPN Curncy	360	United States Dollar 1 Week Deposit
PLN	PZDR1Z CMPN Curncy	365	Polish Zloty 1 Week Deposit
CAD	CDDR1Z CMPN Curncy	360	Canadian Dollar 1 Week Deposit
JPY	JYDR1Z CMPN Curncy	360	Japanese Yen 1 Week Deposit

GBP	BPDR1Z CMPN Curncy	365	British Pound 1 Week Deposit
CHF	SFDR1Z Curncy	360	Swiss Franc 1 Week Deposit
AUD	ADDR1Z CMPN Curncy	360	Australian Dollar 1 Week Deposit
NZD	NDDR1Z CMPN Curncy	360	New Zealand Dollar 1 Week Deposit
CZK	CKDR1Z Curncy	360	Czech Koruna 1 Week Deposit
SEK	SKDR1Z Curncy	360	Swedish Krona 1 Week Deposit
NOK	NKDR1Z Curncy	360	Norwegian Krone 1 Week Deposit
ZAR	SADR1Z CURRENCY	360	South African Rand 1 Week Deposit
HUF	HFDR1Z Curncy	360	Hungarian Forint 1 Week Deposit
RON	RNDR1Z CMPN Curncy	360	Romanian Leu 1 Week Deposit
HKD	HDDR1Z Curncy	360	Hong Kong Dollar 1 Week Deposit
TRY	TYDR1Z CMPN Curncy	360	Turish Lira 1 Week Deposit
MXN	MXNI1M CMPN Curncy	360	Mexican Peso 1 Month Froward Implied Yeld

Przykład.

Kalkulacja dla EURUSD

kurs spot BID : 1,2114

kurs spot ASK : 1,2115

T: 360

Marża: 0,65%

stopa % waluty bazowej BID : -0,5%

stopa % waluty bazowej ASK : -0,37%

stopa % waluty kwotowanej BID : 1,74%

stopa % waluty kwotowanej ASK : 1,82%

$$long\ swap = - \left(1,2114 \times \frac{\left(1 + (1,82\% + 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)}{\left(1 + ((-0,5\%) - 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)} - 1,2114 \right) \times 100000 = -12,1817$$

$$short\ swap = \left(1,2115 \times \frac{\left(1 + (1,74\% - 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)}{\left(1 + ((-0,37\%) + 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)} - 1,2115 \right) \times 100000 = 2,7259$$

Wzory na obliczanie punktów swapowych dla CFD opartych o wartość akcji i ETF.

$$long\ swap = -kurs\ spot_{BID} \left((stopa\ \% + marża) \times \frac{1}{T} \right) \times mnożnik$$

$$short\ swap = kurs\ spot_{ASK} \left((stopa\ \% - marża) \times \frac{1}{T} \right) \times mnożnik$$

long swap - wartość punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

kurs spot BID,ASK – kurs danej pary walutowej w momencie kalkulowania punktów swapowych BID lub ASK;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

T - oznacza ilość dni wg przyjętej dla danej waluty konwencji (np. dla USD rok ma 360 dni, podczas gdy dla PLN 365 dni);

mnożnik – współczynnik wynikający z minimalnego kroku notowań, np. dla EURUSD minimalny krok notowań to 0.00001 dlatego mnożnik w przypadku kalkulacji punktów swapowych będzie wynosił 100 000;

stopa % waluty kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje kwotowania z rynku międzybankowego na podstawie instrumentów przedstawionych w poniższej tabeli:

Waluta	Ticker w Bloomberg	Konwencja liczenia dni (T)	Opis
USD	US0001M Index	360	ICE LIBOR USD 1 Month
EUR	EE0001M Index	360	ICE LIBOR EUR 1 Month
PLN	WIBR1M Index	365	GPW Benchmark WIBOR PLN 1 Month
GBP	BP0001M Index	365	ICE LIBOR GBO 1 Month